

IPS Daily Morning Brief

2020-04-10

종가 기준일 2020-04-09

IRS									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
6M	0.9975	0.00	1.0000	1.0208	1.2349	1.9125	0.9350	1.9125	0.9350
9M	0.9500	0.50	0.9570	0.9873	1.1987	1.9125	0.9050	1.9125	0.9050
1Y	0.9100	0.00	0.9230	0.9606	1.1700	1.9200	0.8750	1.9200	0.8750
1.5Y	0.9150	-0.75	0.9400	0.9688	1.1555	1.9300	0.8650	2.0250	0.8650
2Y	0.9225	-1.50	0.9555	0.9834	1.1424	1.9350	0.8950	2.1150	0.8950
3Y	0.9500	-2.00	0.9890	1.0071	1.1415	1.9375	0.9200	2.2225	0.9200
4Y	0.9825	-3.00	1.0365	1.0513	1.1571	1.9525	0.9050	2.2950	0.9050
5Y	1.0000	-3.75	1.0600	1.0729	1.1632	1.9775	0.8875	2.3400	0.8875
7Y	1.0000	-4.25	1.0650	1.0733	1.1631	2.0100	0.8775	2.3950	0.8775
10Y	1.0450	-5.00	1.1150	1.1136	1.1955	2.0775	0.8925	2.4850	0.8925
12Y	1.0250	-4.25	1.0815	1.0624	1.1833	2.1075	0.8775	2.5225	0.8775
15Y	0.9750	-4.25	1.0305	0.9918	1.1465	2.1100	0.8525	2.5400	0.8525
20Y	0.8400	-4.25	0.8910	0.8366	1.0278	2.1100	0.6975	2.5600	0.6975

6*9M	-4.75	0.50	-4.30	-3.35	-3.63	3.50	-12.50	12.50	-12.50
9*12M	-4.00	-0.50	-3.40	-2.66	-2.87	6.25	-7.50	10.50	-7.50
1*2Y	1.25	-1.50	3.25	2.28	-2.75	7.50	-15.50	23.00	-15.50
2*3Y	2.75	-0.50	3.35	2.38	-0.09	4.00	-5.50	13.25	-5.50
2*4Y	6.00	-1.50	8.10	6.79	1.47	10.50	-8.25	21.75	-8.25
2*5Y	7.75	-2.25	10.45	8.95	2.08	14.50	-10.00	27.25	-10.00
3*4Y	3.25	-1.00	4.75	4.41	1.56	6.50	-3.25	8.50	-3.25
3*5Y	5.00	-1.75	7.10	6.58	2.17	11.00	-5.25	14.00	-5.25
4*5Y	1.75	-0.75	2.35	2.16	0.61	5.25	-2.25	6.25	-2.25
5*7Y	0.00	-0.50	0.50	0.04	-0.01	3.25	-1.75	10.50	-1.75
5*10Y	4.50	-1.25	5.50	4.08	3.24	10.00	0.50	22.25	0.50
7*10Y	4.50	-0.75	5.00	4.04	3.25	7.25	1.50	12.75	1.50
10*12Y	-2.00	0.75	-3.35	-5.13	-1.22	3.00	-9.50	5.50	-9.50
10*15Y	-7.00	0.75	-8.45	-12.19	-4.90	4.50	-18.00	8.00	-18.00
10*20Y	-20.50	0.75	-22.40	-27.70	-16.78	3.50	-35.00	11.25	-35.00

BOND									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	0.828	-0.30	0.867	0.949	1.129	1.918	0.828	1.935	0.828
1.5Y	0.934	-1.70	0.979	1.004	1.159	1.938	0.930	2.113	0.930
2Y	0.952	-2.50	0.994	1.056	1.179	1.950	0.952	2.230	0.952
3Y	0.992	-2.30	1.034	1.082	1.160	1.947	0.022	2.315	0.022
4Y	1.147	-4.10	1.216	1.289	1.310	2.050	1.070	2.502	1.070
5Y	1.202	-5.30	1.277	1.318	1.342	2.070	1.110	2.602	1.110
7Y	1.315	-6.10	1.393	1.443	1.459	2.158	1.163	2.728	1.163
10Y	1.444	-6.90	1.522	1.565	1.544	2.230	1.170	2.815	1.170
20Y	1.545	-5.20	1.616	1.642	1.589	2.172	0.705	2.792	0.705

기타금리	Lv.	전일비
91d CD	1.10	0.00
CALL	0.72	-1.00

국채선물	Lv.	전일비	시	고	저
KTb	111.62	0.10	111.52	111.72	111.40
LKTB	132.75	0.81	132.00	133.02	131.57

BOND SWAP SPRD (1-2Y 동안, 3-10Y 국고,금투협 시가평가 민평평균 기준)									
Tenor	Lv.	전일비	5MA	20MA	60MA	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
1Y	8.20	0.30	5.60	1.21	4.10	12.25	-7.50	12.25	-17.75
1.5Y	-1.90	0.95	-3.88	-3.51	-0.36	4.70	-10.20	4.70	-19.10
2Y	-2.95	1.00	-3.81	-7.28	-3.68	1.75	-12.95	1.75	-25.15
3Y	-4.20	0.30	-4.52	-7.48	-1.89	100.30	-16.45	100.30	-19.50
4Y	-16.45	1.10	-17.93	-23.82	-15.31	-4.50	-33.50	-3.20	-33.50
5Y	-20.20	1.55	-21.70	-24.48	-17.88	-3.20	-33.30	-2.25	-33.30
7Y	-31.50	1.85	-32.78	-36.96	-29.57	-7.85	-45.35	-7.50	-45.35
10Y	-39.90	1.90	-40.66	-45.11	-34.88	-7.50	-55.45	-7.50	-55.45
20Y	-70.50	0.95	-72.52	-80.50	-56.11	52.25	-93.00	52.25	-93.00

BASIS SWAP		CRS						USD/KRW		1219.50 (-1.40)	
Lv.	전일비	Tenor	Lv.	전일비	1Y Max	1Y Min	SPRD	Lv.	전일비		
-98.00	-4.00	1Y	-0.0700	-4.00	1.3900	-1.4500	1*2Y	-5.50	-1.00		
-101.50	-3.75	1.5Y	-0.1000	-4.50	1.3150	1.1000	2*3Y	1.50	-1.50		
-104.75	-3.50	2Y	-0.1250	-5.00	1.2450	1.1000	2*5Y	0.00	0.00		
-106.00	-4.50	3Y	-0.1100	-6.50	1.2400	-0.5650	3*4Y	-1.50	0.00		
-110.75	-3.50	4Y	-0.1250	-6.50	1.2450	-0.4750	3*5Y	-1.50	1.50		
-112.50	-1.25	5Y	-0.1250	-5.00	1.2850	-0.4100	4*5Y	0.00	1.50		
-102.50	-0.75	7Y	-0.0250	-5.00	1.3500	-0.3100	5*7Y	10.00	0.00		
-89.00	-1.50	10Y	0.1550	-6.50	1.5400	-0.1250	5*10Y	28.00	-1.50		

U.S. TREASURY (한국 영업일 기준 전일비)									
Tenor	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
2Y	0.2201	-0.0359	0.2560	0.2680	0.2682	2.8705	0.2101	2.9773	0.2101
10Y	0.7292	-0.0407	0.7699	0.7154	0.6777	3.1250	0.5685	3.2382	0.5685

U.S. TREASURY - KTB (한국 영업일 기준 전일비)									
Tenor	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
2Y	-73.19	-1.09	-72.10	-73.50	-73.78	96.20	-85.69	103.03	-85.69
10Y	-71.48	2.83	-74.31	-86.46	-87.33	92.80	-97.33	98.82	-97.33

SPRD	Lv.	전일비	T-1	T-2	T-3	1Y Max	1Y Min	3Y Max	3Y Min
IRS 2*10Y	12.25	-3.50	15.75	19.75	18.50	19.75	-9.50	42.50	-9.50
KTb 2*10Y	49.20	-4.40	53.60	57.70	54.50	59.20	4.10	68.70	4.10
UST 2*10Y	50.91	-0.48	51.39	44.74	40.95	67.49	-23.40	135.50	-23.40

TODAY MARKET DEAL LEVEL									
IRS			ODD Tenor						
06M									
09M									
01Y	91								
1.5Y									
02Y			SPRD	1*3y 2.5					
03Y	93.5			2*4y 5.75					
04Y				4*5y 2.5					
05Y									
07Y									
10Y	3								
12Y									
15Y									
20Y									
CRS									
TODAY KRX CCP			전일비	T-1	T-2	T-3	T-4	T-5	T-6
거래현황	72 건	-6	78	123	73	72	70	71	
금 액	21,655 억원	-4,939	26,594	33,563	18,835	16,415	24,902	19,116	

장중동향
 국고채 금리. 한국은행 금융통화위원회의 기준금리 동결에도 이주열 총재 발언과 국고채 단순매입 실시 등이 비둘기파적이라는 평가가 강세 채로 작용하며 국고채 금리 하락.

IRS. 한국은행 금융통화위원회가 비둘기 기조로 해석되면서 대부분 구간에서 하락. 단기 구간은 기준금리가 동결됨에 강세가 제한됨.

CRS. 전 구간 하락. 마감